

# VALIDIERUNG VON RISIKOMODELLEN

## BEISPIELPROJEKTE

### Validierung LGD

(Bausparkasse)

- Konzeption Angemessenheitsnachweis eines LGD-Poolmodells im IRB
- Durchführung von Analysen, interne Einwertung der Poolvalidierungsergebnisse, Dokumentation

### Institutsvalidierung IRB

(Immobilienfinanzierer)

- Erstellung Rahmenwerk Validierung Ratingverfahren
- Erstellung Mustervalidierungsbericht
- Fachkonzeption von Validierungsmethoden inkl. Bewertungsschema und Ampellogik

### Validierung Marktrisiko

(Bausparkasse)

- Konzeption und Umsetzung Validierung Zins- und Spreadrisiko
- Erstellung eines Backtesting-Tools für den VaR
- Erstellung Validierungskonzept und -bericht

### Validierung IFRS9 RTF-Projektion

(Bausparkasse)

- Erstellung eines Validierungskonzepts für die Validierung der IFRS9 Impairment-Methodik
- Durchführung und Dokumentation Validierung



Ihr erfahrener  
Partner

### Neuausrichtung Validierung

(Spezialinstitut)

- Erstellung eines Validierungsrahmenwerks
- Konzeption Validierungsmethoden für alle wesentlichen Risikoarten (inkl. Ratingmodelle)
- Umsetzung unabhängige Validierung

### Validierung Stresstest

(Supranationales Institut)

- Erstellung eines Validierungskonzepts und -berichts für den Kreditrisikostresstest
- Durchführung eines Model Reviews